

易方达 50 指数证券投资基金

2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达上证 50 指数
基金主代码	110003
交易代码	110003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 3 月 22 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,323,453,070.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越指数的投资收益,追求长期资本增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金,股票投资部分以上证 50 指数作为标的指数,资产配置上追求充分投资,不根据对市场时机的判断主动调整股票仓位,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的偏离风险,追求超越基准的收益水平。
业绩比较基准	上证 50 指数
风险收益特征	本基金为股票基金,其预期风险、收益水平高于混合基金、债券基金及货币市场基金。本基金在控制与目标指数偏离风险的同时,力争获得超越基准的收益。长期来看,本基金具有与目标指数相近的风险水平。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	汤嵩彦
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tangsy@bankcomm.com

客户服务电话	400 881 8088	95559
传真	020-85104666	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	6,249,694,341.74	-602,026,006.48	-776,244,549.07
本期利润	1,853,181,712.22	7,363,941,783.59	-1,853,951,560.02
加权平均基金份额本期利润	0.1477	0.3550	-0.0763
本期基金份额净值增长率	3.81%	60.94%	-11.35%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0268	-0.5122	-0.4836
期末基金资产净值	8,776,418,409.22	20,080,592,113.35	13,695,358,840.38
期末基金份额净值	1.0544	1.0157	0.6311

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.19%	1.51%	12.80%	1.61%	0.39%	-0.10%
过去六个月	-10.03%	2.30%	-15.65%	2.63%	5.62%	-0.33%
过去一年	3.81%	2.27%	-6.23%	2.53%	10.04%	-0.26%
过去三年	48.11%	1.73%	30.31%	1.91%	17.80%	-0.18%
过去五年	39.23%	1.54%	22.43%	1.67%	16.80%	-0.13%
自基金合同生	218.07%	1.71%	125.88%	1.85%	92.19%	-0.14%

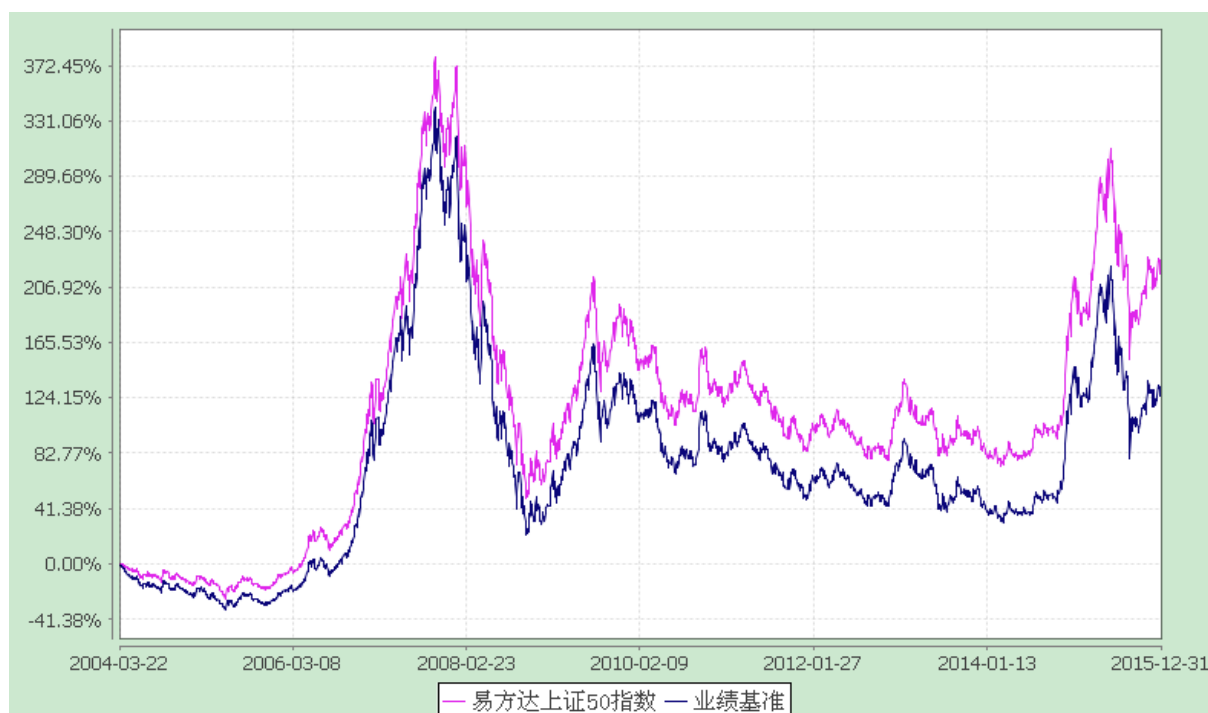
效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达 50 指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004 年 3 月 22 日至 2015 年 12 月 31 日)

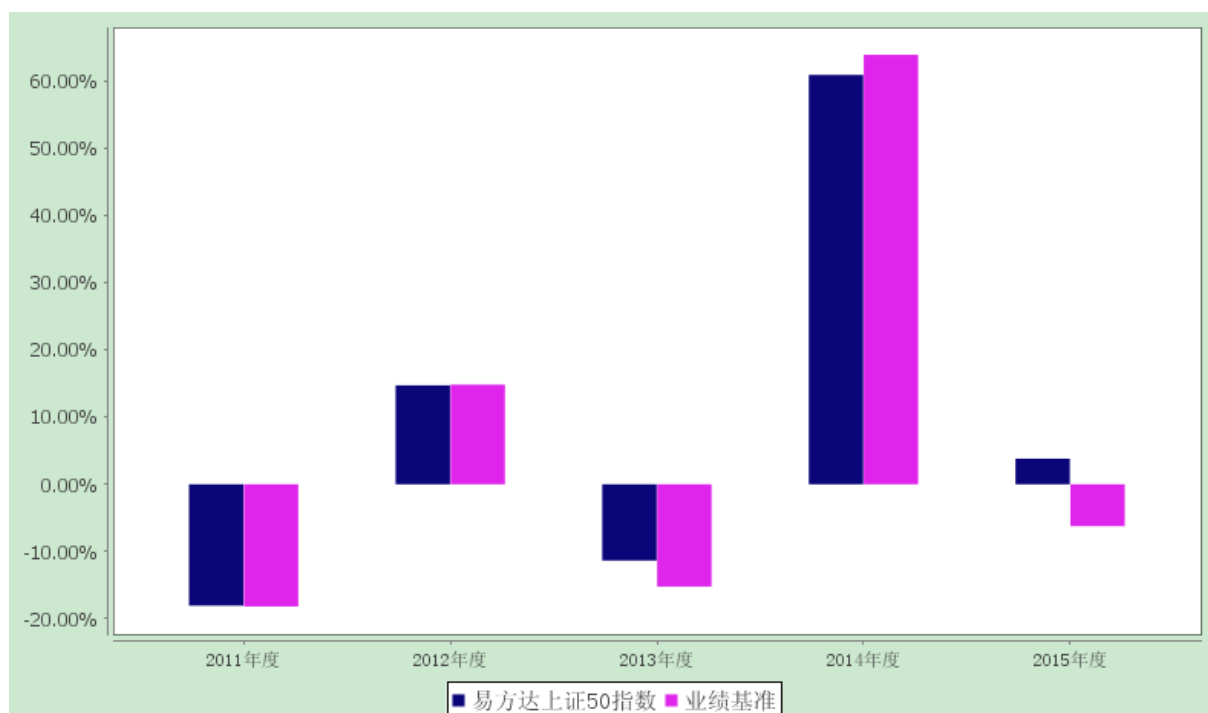


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 218.07%，同期业绩比较基准收益率为 125.88%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达 50 指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日,注册资本 1.2 亿元,旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场,取信于社会”的宗旨,坚持“在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念,以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩,赢得市场认可。2004 年 10 月,易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月,易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月,易方达获得合格境内机构投资者(QDII)资格。2008 年 2 月,易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 12 月 31 日,易方达旗下共管理 88 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务,资产管理总规模 8269.58 亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林飞	本基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理（自 2013 年 03 月 06 日至 2015 年 06 月 05 日）、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理（自 2006 年 07 月 04 日至 2015 年 06 月 05 日）、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（自 2009 年 12 月 01 日至 2015 年 06 月 05 日）、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理	2007-02-10	2015-06-06	12 年	博士研究生，曾任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、易方达沪深 300 指数证券投资基金基金经理。
张胜记	本基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理助理	2012-09-28	-	10 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在

本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2015 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交

易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次，其中 8 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，国内经济增速在低位徘徊，全年 GDP 增速为 6.9%，比上年回落 0.4 个百分点。全年固定资产投资增速 10.0%，房地产投资增速回落到 1.0%，社会消费品零售总额比上年增长 10.7%，进出口总额同比下降 7.0%。贸易顺差 3.7 万亿元。物价水平整体温和，全年消费品价格指数 CPI 为 1.4%，工业品出厂价格指数 PPI 为 -5.2%。货币投放力度加大，广义货币供应量 M2 同比增长 13.3%，处于较高水平。在经济基本面情况不佳的背景下，政府政策的放松力度进一步加大。央行先后四次降息共 100 个 BP，四次降低银行存款准备金率共 2 个百分点，同时对商业银行等金融机构不再设置存款利率浮动上限，利率市场化程度大幅提升。汇率方面，央行于 8 月 11 日决定完善人民币兑美元汇率中间价报价制度，每日中间价的形成主要参考上日银行间外汇市场收盘汇率，阶段性贬值预期出现。另一方面，财政刺激政策密集出台，包括降低房地产首付比例、1.6 升排量以下乘用车购置税减半等刺激房地产、汽车消费。在市场流动性充裕的大背景下，A 股市场大幅上涨，大小盘风格差异巨大。报告期内，上证指数上涨 9.41%，创业板、中小板涨幅分别达 84.4%、53.7%，上证 50 数下跌 6.23%。从行业表现来看，计算机、轻工、传媒、电子等板块涨幅居前；证券、保险、银行、采掘等行业表现落后。

本基金是跟踪上证 50 指数的增强型指数基金，股票仓位根据合同要求一直保持在 90% 以上，在行业配置上，多数行业与指数权重分布一致，医药、食品饮料、TMT 等行业有一定的超配，银行、建筑建材等行业有所低配。报告期内，根据对市场形势的判断，本基金进行了一些结构调整操作，主要是降低了银行、建筑、公用事业等板块的权重，增加了 TMT、券商、医药等板块的配置。本基金报告期业绩领先基准指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0544 元，本报告期份额净值增长率为 3.81%，同期业绩比较基准收益率为-6.23%，年化跟踪误差 5.90%，主要是组合配置与指数偏离较大、市场波动较大等因素所致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，新股 IPO 重启、注册制有望推出，经历大幅反弹后的 A 股市场，小盘股的估值重新回到高位，面临一定的压力。另一方面，财政刺激政策将逐渐发挥效果，汽车、房地产等行业在政策鼓励下有望继续回暖，中央经济政策加码供给侧改革，传统行业有望走出低谷。A 股市场在目前水平上保持稳定的可能性较大，基本面预期改善的传统行业有望重新成为市场的热点。

上证 50 指数的整体估值较低，股息收益率较高，本基金根据基金合同的要求将继续保持 90%以上的股票配置。另一方面，将继续深入研究各成分股的前景，在市场调整阶段，积极增加具有长期竞争力、业绩增长稳定的成分股配置，平衡组合的结构，力争为投资者带来超越基准指数的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期不满足分红条件，不进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015 年度，基金托管人在易方达 50 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015 年度，易方达基金管理有限公司在易方达 50 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年度，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达 50 指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	184,286,864.82	239,912,419.88
结算备付金	5,240,648.58	4,054,507.32
存出保证金	2,364,589.17	2,024,922.27
交易性金融资产	8,599,721,139.03	20,027,764,183.25
其中：股票投资	8,277,603,682.83	19,022,574,924.95
基金投资	-	-

债券投资	322,117,456.20	1,005,189,258.30
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	46,420,120.19	61,143,486.05
应收利息	9,958,717.40	18,302,958.04
应收股利	-	-
应收申购款	3,685,525.00	122,624,373.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,851,677,604.19	20,475,826,850.21
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	270,189,394.71
应付证券清算款	51,424,093.63	-
应付赎回款	9,834,820.55	99,852,345.96
应付管理人报酬	8,988,440.99	17,786,955.00
应付托管费	1,498,073.51	2,964,492.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,082,723.47	3,701,384.57
应交税费	-	-
应付利息	-	103,301.73
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-

其他负债	431,042.82	636,862.40
负债合计	75,259,194.97	395,234,736.86
所有者权益：		
实收基金	8,323,453,070.90	19,769,782,162.95
未分配利润	452,965,338.32	310,809,950.40
所有者权益合计	8,776,418,409.22	20,080,592,113.35
负债和所有者权益总计	8,851,677,604.19	20,475,826,850.21

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0544 元，基金份额总额 8,323,453,070.90 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	2,089,503,765.05	7,571,739,382.05
1.利息收入	26,409,170.93	30,772,623.98
其中：存款利息收入	3,065,026.55	1,573,576.39
债券利息收入	22,500,865.24	28,938,999.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	843,279.14	260,048.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,440,970,702.92	-430,356,727.87
其中：股票投资收益	6,168,009,300.36	-796,412,269.50
基金投资收益	-	-
债券投资收益	46,698,701.07	1,341,858.68
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	226,262,701.49	364,713,682.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,396,512,629.52	7,965,967,790.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	18,636,520.72	5,355,695.87
减：二、费用	236,322,052.83	207,797,598.46
1. 管理人报酬	161,772,943.68	161,422,050.49
2. 托管费	26,962,157.30	26,903,675.16
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	41,894,320.63	17,266,779.72
5. 利息支出	5,187,046.60	1,692,788.08
其中：卖出回购金融资产支出	5,187,046.60	1,692,788.08
6. 其他费用	505,584.62	512,305.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,853,181,712.22	7,363,941,783.59
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,853,181,712.22	7,363,941,783.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,769,782,162.95	310,809,950.40	20,080,592,113.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,853,181,712.22	1,853,181,712.22

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-11,446,329,092.05	-1,711,026,324.30	-13,157,355,416.35
其中：1.基金申购款	10,628,102,884.01	1,237,699,772.96	11,865,802,656.97
2.基金赎回款	-22,074,431,976.06	-2,948,726,097.26	-25,023,158,073.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,323,453,070.90	452,965,338.32	8,776,418,409.22
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,701,526,766.67	-8,006,167,926.29	13,695,358,840.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,363,941,783.59	7,363,941,783.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,931,744,603.72	953,036,093.10	-978,708,510.62
其中：1.基金申购款	9,869,902,667.32	-2,570,562,070.79	7,299,340,596.53
2.基金赎回款	-11,801,647,271.04	3,523,598,163.89	-8,278,049,107.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	19,769,782,162.95	310,809,950.40	20,080,592,113.35
-----------------	-------------------	----------------	-------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达 50 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]13 号文《关于同意易方达 50 指数证券投资基金设立的批复》的批准，由易方达基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开发行募集并于 2004 年 3 月 22 日正式成立，首次设立募集规模为 5,048,902,330.26 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为易方达基金管理有限公司，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述事项外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收

益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰, 由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。

证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入, 由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 减按 25% 计入应纳税所得额; 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人

所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达海外投资（深圳）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	8,169,024,127.26	32.93%	4,309,588,264.62	37.56%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券	7,465,063.76	36.41%	931,097.13	30.22%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	3,923,443.25	39.76%	1,225,991.20	33.19%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	161,772,943.68	161,422,050.49
其中：支付销售机构的客户维护费	30,834,050.14	32,197,183.57

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	26,962,157.30	26,903,675.16

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	81,139,784.11	-	-	-	300,000,000.00	174,399.04

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
报告期初持有的基金份额	-	365,009,506.23
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	365,009,506.23
报告期末持有的基金份额	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
---------------------	---	---

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广东省易方达教育基金会	-	-	39,329,962.07	0.20%
易方达资产管理有限公司	579,929.60	0.01%	-	-
易方达海外投资(深圳)有限公司	187,959.13	0.00%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	184,286,864.82	2,888,141.32	239,912,419.88	1,501,929.52

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	002741	光华科技	新股网下 发行	44,444	547,105.64
广发证券	603898	好莱客	新股网下 发行	67,555	1,322,051.35
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	603010	万盛股份	新股网下 发行	14,119	165,192.30
广发证券	603100	川仪股份	新股网下 发行	8,508	57,173.76

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量（单位： 股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300394	天孚 通信	2015-02-12	2016-02-17	老股 转让 流通 受限	21.41	115.5 0	148,344	3,176,045.04	17,133,732.00	-
300477	合纵 科技	2015-06-04	2016-06-10	老股 转让 流通 受限	10.61	53.00	32,174	341,366.14	1,705,222.00	-
300488	恒锋 工具	2015-06-25	2016-07-01	老股 转让 流通 受限	20.11	88.80	71,341	1,434,667.51	6,335,080.80	-

注：（1）苏州天孚光通信股份有限公司于 2015 年 5 月 21 日（流通受限期内），向全体股东每

10 股派 5 元人民币现金（含税）；

（2）以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大事项 停牌	9.92	2016-02-01	8.93	5,599,450	66,587,341.15	55,546,544.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 8,222,057,138.83 元，属于第二层次的余额为 377,664,000.20 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 19,137,846,781.94 元，第二层次 889,917,401.31 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、

或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于 2015 年 3 月 19 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,277,603,682.83	93.51
	其中：股票	8,277,603,682.83	93.51
2	固定收益投资	322,117,456.20	3.64
	其中：债券	322,117,456.20	3.64
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	189,527,513.40	2.14
7	其他各项资产	62,428,951.76	0.71
8	合计	8,851,677,604.19	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	263,744,930.20	3.01
C	制造业	1,156,661,781.93	13.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,197,084.16	1.10
E	建筑业	290,069,013.00	3.31
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	79,324,389.20	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	165,549,269.37	1.89
J	金融业	4,786,484,796.96	54.54
K	房地产业	146,100,287.20	1.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,984,131,552.02	79.58

8.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,054,261.00	0.02
C	制造业	700,195,086.14	7.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,913,148.05	0.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	402,616.44	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	631,884.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	286,793,988.52	3.27
J	金融业	286,864,104.45	3.27
K	房地产业	1,507,650.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	1,293,472,130.81	14.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	24,169,196	870,091,056.00	9.91
2	600016	民生银行	56,136,203	541,152,996.92	6.17
3	601166	兴业银行	26,835,521	458,082,343.47	5.22
4	600519	贵州茅台	1,977,496	431,469,852.24	4.92
5	600036	招商银行	21,969,029	395,222,831.71	4.50
6	600000	浦发银行	16,199,749	295,969,414.23	3.37
7	600837	海通证券	18,161,518	287,315,214.76	3.27
8	600030	中信证券	12,428,791	240,497,105.85	2.74
9	601668	中国建筑	37,931,310	240,484,505.40	2.74
10	601169	北京银行	20,640,651	217,346,055.03	2.48

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	23,867,955	286,176,780.45	3.26
2	002153	石基信息	1,044,845	157,771,595.00	1.80
3	000661	长春高新	1,309,249	157,699,042.05	1.80
4	002241	歌尔声学	3,199,824	110,713,910.40	1.26
5	300113	顺网科技	800,000	81,096,000.00	0.92

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	601766	中国中车	510,031,713.06	2.54
2	601166	兴业银行	351,333,360.85	1.75
3	000001	平安银行	306,289,632.27	1.53
4	601398	工商银行	277,490,916.49	1.38
5	600016	民生银行	256,836,222.14	1.28
6	600030	中信证券	218,930,174.94	1.09
7	000550	江铃汽车	209,874,801.02	1.05
8	600837	海通证券	209,677,219.67	1.04
9	601988	中国银行	204,931,551.68	1.02
10	601601	中国太保	188,078,899.29	0.94
11	000661	长春高新	160,738,279.20	0.80
12	002153	石基信息	149,251,747.20	0.74
13	002241	歌尔声学	144,122,142.81	0.72
14	601989	中国重工	140,027,795.36	0.70
15	600150	中国船舶	131,953,427.57	0.66
16	600000	浦发银行	125,459,039.71	0.62
17	600109	国金证券	124,568,903.05	0.62
18	601818	光大银行	119,618,630.91	0.60
19	600036	招商银行	113,148,178.97	0.56
20	600999	招商证券	103,940,912.41	0.52

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资 产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,297,231,861.59	6.46
2	600000	浦发银行	1,202,263,065.11	5.99
3	601166	兴业银行	1,161,975,893.76	5.79
4	600036	招商银行	1,135,588,233.25	5.66
5	600519	贵州茅台	1,005,750,915.25	5.01
6	600016	民生银行	989,716,811.68	4.93
7	600030	中信证券	946,709,831.31	4.71
8	601668	中国建筑	779,035,930.76	3.88
9	601766	中国中车	776,601,982.11	3.87
10	601299	中国北车	704,442,684.68	3.51
11	601601	中国太保	689,619,746.26	3.43
12	600837	海通证券	664,079,134.04	3.31

13	600048	保利地产	539,743,541.03	2.69
14	000001	平安银行	358,120,584.34	1.78
15	600050	中国联通	351,540,427.21	1.75
16	601989	中国重工	329,699,901.99	1.64
17	002179	中航光电	287,304,540.22	1.43
18	601398	工商银行	286,424,612.50	1.43
19	601288	农业银行	275,765,643.00	1.37
20	601088	中国神华	256,891,601.42	1.28

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,599,469,136.83
卖出股票收入（成交）总额	19,161,450,882.77

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,574,456.20	0.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,543,000.00	3.65
	其中：政策性金融债	320,543,000.00	3.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	322,117,456.20	3.67

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150416	15 农发 16	1,000,000	100,230,000.00	1.14
2	018001	国开 1301	1,000,000	100,010,000.00	1.14
3	130219	13 国开 19	600,000	60,216,000.00	0.69
4	150311	15 进出 11	500,000	50,050,000.00	0.57
5	140305	14 进出 05	100,000	10,037,000.00	0.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 根据中信证券股份有限公司 2015 年 11 月 26 日发布的《关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

根据海通证券股份有限公司 2015 年 11 月 27 日发布的《收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，被中国证监会予以立案调查。根据海通证券股份有限公司 2015 年 9 月 11 日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，被中国证监会予以警告及行政处罚。根据海通证券股份有限公司 2015 年 8 月 25 日发布的《收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，被中国证监会予以立案调查。在上述公告公布后，本基金管理人对上述两家上市公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对中信证券、海通证券的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述两家上市公司

的投资判断未发生改变。

除中信证券、海通证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,364,589.17
2	应收证券清算款	46,420,120.19
3	应收股利	-
4	应收利息	9,958,717.40
5	应收申购款	3,685,525.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,428,951.76

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
527,652	15,774.51	86,567,409.07	1.04%	8,236,885,661.83	98.96%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	627,466.21	0.0075%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004 年 3 月 22 日)基金份额总额	5,048,902,330.26
本报告期期初基金份额总额	19,769,782,162.95
本报告期基金总申购份额	10,628,102,884.01
减：本报告期基金总赎回份额	22,074,431,976.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,323,453,070.90

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内，交通银行股份有限公司(以下简称“本行”)因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 12 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 120,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	1,024,665,154.47	4.13%	932,853.77	4.55%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	1,785,440,026.86	7.20%	1,634,247.39	7.97%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	660,908,300.86	2.66%	601,688.80	2.93%	-
申万宏源	1	911,378,880.77	3.67%	829,717.13	4.05%	-
国都证券	1	161,709,474.55	0.65%	150,600.88	0.73%	-
光大证券	1	4,898,875,679.68	19.75%	4,490,991.56	21.90%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	1,742,690,884.40	7.02%	1,586,541.80	7.74%	-
东北证券	1	5,250,786,316.70	21.16%	2,625,393.24	12.80%	-
海通证券	1	204,522,636.41	0.82%	186,197.80	0.91%	-
广发证券	3	8,169,024,127.26	32.93%	7,465,063.76	36.41%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元;齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司,中信金通证券公司更名为中信证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

- 1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	385,116.00	0.13%	120,700,000.00	16.68%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	11,158,227.50	3.71%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	111,292,000.00	36.97%	170,000,000.00	23.49%	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	117,387,802.82	39.00%	400,000,000.00	55.27%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	60,780,710.20	20.19%	33,000,000.00	4.56%	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日